

บทคัดย่อ

T 154180

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์ผลกระทบจากความผันผวนของค่าเงินบาทในช่วงเวลาปี พ.ศ. 2540 ถึง พ.ศ. 2546 ที่มีต่อการส่งออกกุ้งแช่แข็งของประเทศไทย โดยนำวิธีทดสอบ Cointegration ของ Engle และ Granger (1987) มาประยุกต์ใช้ในการทดสอบ โดยนำตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์มหภาคมาประกอบการศึกษา อันได้แก่ อัตราแลกเปลี่ยน ดัชนีอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง ดัชนีการผลิตของภาคอุตสาหกรรม รายได้ที่แท้จริง ปริมาณการส่งออก และมูลค่าการส่งออก

จากการศึกษาแบบจำลองปริมาณการส่งออก และแบบจำลองมูลค่าการส่งออกกุ้งแช่แข็งของประเทศไทย พบว่า ตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยน ดัชนีอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง และปริมาณการส่งออกกุ้งในอดีต มูลค่าการส่งออกกุ้งในอดีต รายได้ที่แท้จริงของสหรัฐอเมริกา ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน มีความสัมพันธ์ระยะยาวกันอย่างมีนัยสำคัญ เมื่อนำแบบจำลองทั้งสองไปพิจารณา ร่วมกับผลการศึกษาของวิธีกำลังสองน้อยที่สุดอย่างง่าย (Ordinary Least Square: OLS) พบว่าในแบบจำลองปริมาณการส่งออกกุ้ง ตัวแปรรายได้ที่แท้จริงของสหรัฐอเมริกา ดัชนีการผลิตของภาคอุตสาหกรรมสหรัฐอเมริกา และความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ไม่มีอิทธิพลต่อปริมาณการส่งออกกุ้งแช่แข็งของประเทศไทย ส่วนแบบจำลองมูลค่าการส่งออกกุ้ง มีเพียงมูลค่าการส่งออกกุ้งในอดีตเท่านั้นที่มีอิทธิพลต่อมูลค่าการส่งออกกุ้งของไทย

ABSTRACT

TE 154180

The objective of this study is to analyse the effects of the exchange rate movement on frozen shrimp-export of Thailand for the period of 1997-2003 by using the cointegration technique introduced by Engle and Granger (1987). The macroeconomic variables ,namely, exchange rate, real effective exchange rate index, manufacturing production index, personal income, quantity of export and value of export are utilized in this paper.

The empirical evidence shows that all variables in both quantity of export and value of export models exhibit significant long-term relationships. Furthermore, the ordinary least square method (OLS) indicates that quantity of export , manufacturing production index and risk from exchange rate variables are significant to justify the quantity of shrimp export model. However, in the value of shrimp-export model, only the lagged value of export variable is significant.